

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成26年5月23日

【発行者名】 三菱UFJ投信株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 後藤 俊夫

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【事務連絡者氏名】 井上 靖  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号

【電話番号】 03-6250-4740

【届出の対象とした募集内国投資信託 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）  
受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資信託 継続募集額 上限1兆円  
受益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 該当ありません

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で<sup>訂正</sup>有価証券報告書を提出致しましたので、平成25年11月25日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、提出するものです。

## 【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_は訂正部分を示し、原届出書の更新後の内容を記載する場合は<更新後>とし、原届出書に追加される内容を記載する場合は<追加>とします。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (3)【ファンドの仕組み】

## 委託会社の概況

<訂正前>

- ・資本金  
2,000百万円（平成25年9月末現在）  
（略）
- ・大株主の状況（平成25年9月末現在）  
（略）

<訂正後>

- ・資本金  
2,000百万円（平成26年3月末現在）  
（略）
- ・大株主の状況（平成26年3月末現在）  
（略）

## 2【投資方針】

## (3)【運用体制】

<訂正前>

（略）

ファンドの運用体制等は平成25年11月26日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

<訂正後>

（略）

ファンドの運用体制等は平成26年5月24日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

<更新後>

（略）

信託財産の純資産総額 × 年1.134%（税抜 年1.05%）

（略）

委託会社	販売会社	受託会社
年0.972% (税抜 年0.9%)	年0.054% (税抜 年0.05%)	年0.108% (税抜 年0.1%)

（略）

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

## (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

（略）

## 個人の受益者に対する課税

(略)

## 1. 収益分配金の課税

(略)

原則として、10.147% (所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。

(略)

## 2. 解約時および償還時の課税

(略)

10.147% (所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、10.147% (所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

(略)

平成26年1月1日以降の税率は、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)となる予定です。

## 法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として7.147% (所得税7%、復興特別所得税0.147%)の税率で源泉徴収されます。

(略)

平成26年1月1日以降の税率は、15.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%)となる予定です。

(略)

上記は平成25年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

## &lt;訂正後&gt;

(略)

## 個人の受益者に対する課税

(略)

## 1. 収益分配金の課税

(略)

原則として、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。

(略)

## 2. 解約時および償還時の課税

(略)

20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

(略)

## 法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収されます。

(略)

上記は平成26年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

## 5【運用状況】

&lt;更新後&gt;

## (1)【投資状況】

平成26年3月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	967,669,616	99.76
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,306,429	0.24
純資産総額		969,976,045	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## a 評価額上位30銘柄

平成26年3月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	親投資信託 受益証券		742,191,760	1.3323 1.3038	988,883,534 967,669,616		99.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成26年3月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.76
合計	99.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成26年3月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成18年 8月24日)	139,228,847 (分配付) 139,228,847 (分配落)	10,038 (分配付) 10,038 (分配落)
第2計算期間末日 (平成19年 2月26日)	821,000,277 (分配付) 821,000,277 (分配落)	10,002 (分配付) 10,002 (分配落)
第3計算期間末日 (平成19年 8月24日)	700,518,538 (分配付) 700,518,538 (分配落)	10,238 (分配付) 10,238 (分配落)
第4計算期間末日 (平成20年 2月25日)	605,542,981 (分配付) 605,542,981 (分配落)	10,125 (分配付) 10,125 (分配落)
第5計算期間末日 (平成20年 8月25日)	415,396,478 (分配付) 415,396,478 (分配落)	10,068 (分配付) 10,068 (分配落)
第6計算期間末日 (平成21年 2月24日)	263,099,909 (分配付) 263,099,909 (分配落)	9,831 (分配付) 9,831 (分配落)
第7計算期間末日 (平成21年 8月24日)	339,284,838 (分配付) 339,284,838 (分配落)	10,730 (分配付) 10,730 (分配落)
第8計算期間末日 (平成22年 2月24日)	320,060,928 (分配付) 320,060,928 (分配落)	10,631 (分配付) 10,631 (分配落)
第9計算期間末日 (平成22年 8月24日)	316,440,035 (分配付) 316,440,035 (分配落)	10,956 (分配付) 10,956 (分配落)

第10計算期間末日 (平成23年 2月24日)	216,544,993 (分配付) 216,544,993 (分配落)	11,523 (分配付) 11,523 (分配落)
第11計算期間末日 (平成23年 8月24日)	158,646,057 (分配付) 158,646,057 (分配落)	11,366 (分配付) 11,366 (分配落)
第12計算期間末日 (平成24年 2月24日)	97,056,812 (分配付) 97,056,812 (分配落)	11,470 (分配付) 11,470 (分配落)
第13計算期間末日 (平成24年 8月24日)	67,598,183 (分配付) 67,598,183 (分配落)	10,966 (分配付) 10,966 (分配落)
第14計算期間末日 (平成25年 2月25日)	50,499,625 (分配付) 50,499,625 (分配落)	11,507 (分配付) 11,507 (分配落)
第15計算期間末日 (平成25年 8月26日)	533,985,269 (分配付) 533,985,269 (分配落)	11,494 (分配付) 11,494 (分配落)
第16計算期間末日 (平成26年 2月24日)	904,211,437 (分配付) 904,211,437 (分配落)	11,732 (分配付) 11,732 (分配落)
平成25年 3月末日	99,523,001	11,418
4月末日	330,431,346	11,396
5月末日	384,478,266	11,580
6月末日	425,432,454	11,601
7月末日	490,969,907	11,467
8月末日	532,979,367	11,472
9月末日	575,738,649	11,549
10月末日	949,923,400	11,577
11月末日	791,756,599	11,617
12月末日	604,309,376	11,739
平成26年 1月末日	806,808,750	11,872
2月末日	898,423,974	11,657
3月末日	969,976,045	11,452

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円
第16計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率 (%)
第1計算期間	0.38
第2計算期間	0.35
第3計算期間	2.35
第4計算期間	1.10
第5計算期間	0.56
第6計算期間	2.35
第7計算期間	9.14
第8計算期間	0.92
第9計算期間	3.05
第10計算期間	5.17

第11計算期間	1.36
第12計算期間	0.91
第13計算期間	4.39
第14計算期間	4.93
第15計算期間	0.11
第16計算期間	2.07

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	149,581,333	10,886,124	138,695,209
第2計算期間	717,201,050	35,038,542	820,857,717
第3計算期間	431,197,442	567,842,349	684,212,810
第4計算期間	265,784,731	351,943,620	598,053,921
第5計算期間	66,273,853	251,723,148	412,604,626
第6計算期間	109,388,491	254,358,230	267,634,887
第7計算期間	105,011,219	56,430,581	316,215,525
第8計算期間	56,944,779	72,083,445	301,076,859
第9計算期間	15,058,155	27,298,131	288,836,883
第10計算期間	6,617,181	107,527,505	187,926,559
第11計算期間	36,086,244	84,439,182	139,573,621
第12計算期間	693,280	55,652,582	84,614,319
第13計算期間	890,000	23,862,803	61,641,516
第14計算期間	32,370,796	50,128,191	43,884,121
第15計算期間	434,451,663	13,749,453	464,586,331
第16計算期間	694,931,787	388,810,335	770,707,783

#### <参考>

#### 「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」

#### (1) 投資状況

平成26年3月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	864,333,000	81.07
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		201,856,579	18.93
純資産総額		1,066,189,579	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### (2) 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### a 評価額上位30銘柄

平成26年3月31日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	帝国繊維	株式	繊維製品	3,200	1,393.00	4,457,600		0.47
					1,576.00	5,043,200		
日本	トラスト・テック	株式	サービス業	2,900	1,304.00	3,781,600		0.44
					1,618.00	4,692,200		
日本	日本ペイント	株式	化学	3,000	1,542.66	4,628,000		0.44
					1,564.00	4,692,000		
日本	長谷川香料	株式	化学	2,700	1,533.00	4,139,100		0.43
					1,691.00	4,565,700		
日本	ローランド ディー・ジー	株式	電気機器	1,100	3,519.00	3,870,900		0.42
					4,085.00	4,493,500		
日本	SUMCO	株式	金属製品	5,600	750.00	4,200,000		0.42
					797.00	4,463,200		
日本	東亜合成	株式	化学	10,000	431.00	4,310,000		0.41
					442.00	4,420,000		
日本	日本海洋掘削	株式	鉱業	1,000	4,177.00	4,177,000		0.41
					4,415.00	4,415,000		

日本	東京個別指導学院	株式	サービス業	9,600	389.00 458.00	3,734,400 4,396,800		0.41
日本	S Foods	株式	食料品	4,000	1,059.25 1,094.00	4,237,000 4,376,000		0.41
日本	大同メタル工業	株式	輸送用機器	4,000	934.00 1,084.00	3,736,000 4,336,000		0.41
日本	立花エレテック	株式	卸売業	3,100	1,261.00 1,393.00	3,909,100 4,318,300		0.41
日本	国際石油開発帝石	株式	鉱業	3,200	1,308.00 1,339.00	4,185,600 4,284,800		0.40
日本	ノーリツ鋼機	株式	精密機器	5,900	642.00 726.00	3,787,800 4,283,400		0.40
日本	淀川製鋼所	株式	鉄鋼	10,000	410.00 427.00	4,100,000 4,270,000		0.40
日本	日本電気硝子	株式	ガラス・土石製品	8,000	480.00 531.00	3,840,000 4,248,000		0.40
日本	大平洋金属	株式	鉄鋼	11,000	336.00 385.00	3,696,000 4,235,000		0.40
日本	スター精密	株式	電気機器	3,400	1,199.00 1,244.00	4,076,600 4,229,600		0.40
日本	旭有機材工業	株式	化学	18,000	230.00 233.00	4,140,000 4,194,000		0.39
日本	ピジョン	株式	その他製品	900	4,450.00 4,660.00	4,005,000 4,194,000		0.39
日本	パラマウントベッドホールディングス	株式	その他製品	1,300	3,183.69 3,225.00	4,138,800 4,192,500		0.39
日本	信越ポリマー	株式	化学	10,800	382.00 386.00	4,125,600 4,168,800		0.39
日本	大正製薬ホールディングス	株式	医薬品	500	7,640.00 8,310.00	3,820,000 4,155,000		0.39
日本	コクヨ	株式	その他製品	5,500	695.00 755.00	3,822,500 4,152,500		0.39
日本	稲葉製作所	株式	金属製品	3,200	1,244.00 1,296.00	3,980,800 4,147,200		0.39
日本	コカ・コーライーストジャパン	株式	食料品	1,600	2,431.00 2,590.00	3,889,600 4,144,000		0.39
日本	鴻池運輸	株式	陸運業	2,600	1,380.00 1,592.00	3,588,000 4,139,200		0.39
日本	アイカ工業	株式	化学	1,800	2,167.00 2,299.00	3,900,600 4,138,200		0.39
日本	ザ・バック	株式	パルプ・紙	2,100	1,947.00 1,970.00	4,088,700 4,137,000		0.39
日本	日本電工	株式	鉄鋼	15,000	269.00 275.00	4,035,000 4,125,000		0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成26年3月31日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
水産・農林業	0.35
鉱業	1.58
建設業	3.64
食料品	3.26
繊維製品	1.89
パルプ・紙	0.39
化学	8.66
医薬品	2.80
ゴム製品	0.33
ガラス・土石製品	2.06
鉄鋼	2.89
非鉄金属	1.06
金属製品	1.83
機械	7.84
電気機器	8.91
輸送用機器	4.73
精密機器	0.76
その他製品	2.10
電気・ガス業	0.26
陸運業	1.75
海運業	0.36
倉庫・運輸関連業	0.33
情報・通信業	3.99
卸売業	6.15
小売業	6.55
不動産業	2.49
サービス業	4.09

合計	81.07
----	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## [ 参考情報 ]

## 運用実績

## 1 基準価額・純資産の推移(設定日～2014年3月31日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもとして計算

## 2 分配の推移

2014年 2月	0円
2013年 8月	0円
2013年 2月	0円
2012年 8月	0円
2012年 2月	0円
2011年 8月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

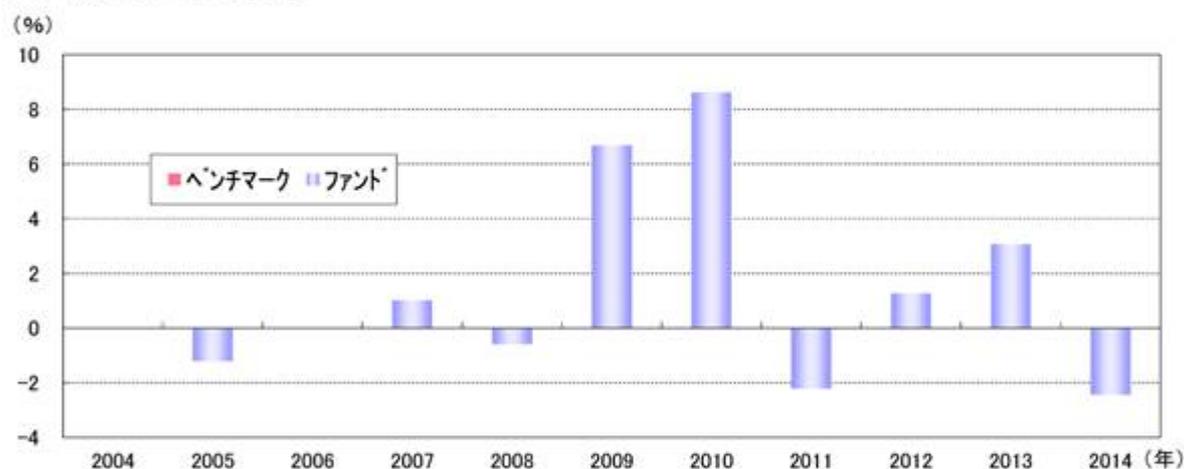
## 3 主要な資産の状況(2014年3月31日現在)

資産別構成	比率
国内株式現物	80.9%
国内株式信用売	-82.0%
株式(実質)	-1.1%

	組入上位銘柄	業種	比率
1	帝国繊維	繊維製品	0.5%
2	トラスト・テック	サービス業	0.4%
3	日本ペイント	化学	0.4%
4	長谷川香料	化学	0.4%
5	ローランド ディー、ジー、	電気機器	0.4%
6	SUMCO	金属製品	0.4%
7	東亜合成	化学	0.4%
8	日本海洋掘削	鉱業	0.4%
9	東京個別指導学院	サービス業	0.4%
10	S Foods	食料品	0.4%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

## 4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2005年は設定日から年末までの、2014年は3月31日までの収益率を表示
- ・2004年はベンチマークの年間収益率を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(平成25年8月27日から平成26年2月24日まで)の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

【日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）】

## (1)【貸借対照表】

	第 15 期	第 16 期
	[ 平成25年8月26日現在 ]	[ 平成26年2月24日現在 ]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,112,629	6,092,525
親投資信託受益証券	532,713,540	902,054,205
未収利息	5	10
流動資産合計	535,826,174	908,146,740
資産合計	535,826,174	908,146,740
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	174,905	373,876
未払委託者報酬	1,661,517	3,551,766
その他未払費用	4,483	9,661
流動負債合計	1,840,905	3,935,303
負債合計	1,840,905	3,935,303
純資産の部		
元本等		
元本	1 464,586,331	770,707,783
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	69,398,938	133,503,654
( 分配準備積立金 )	(5,172,558)	(9,627,531)
元本等合計	533,985,269	904,211,437
純資産合計	533,985,269	904,211,437
負債純資産合計	535,826,174	908,146,740

## (2)【損益及び剰余金計算書】

	第 15 期	第 16 期
	自 平成25年 2月26日 至 平成25年 8月26日	自 平成25年 8月27日 至 平成26年 2月24日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	521	1,390
有価証券売買等損益	5,439,168	14,508,508
営業収益合計	5,439,689	14,509,898
営業費用		
受託者報酬	174,905	373,876
委託者報酬	1,661,517	3,551,766
その他費用	4,483	9,661
営業費用合計	1,840,905	3,935,303
営業利益	3,598,784	10,574,595
経常利益	3,598,784	10,574,595
当期純利益	3,598,784	10,574,595
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	97,674	3,951,141
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	6,615,504	69,398,938
剰余金増加額又は欠損金減少額	61,099,405	116,483,181
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	61,099,405	116,483,181
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,012,429	59,001,919
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,012,429	59,001,919
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	69,398,938	133,503,654

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月24日および8月24日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成25年8月27日から平成26年2月24日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第 15 期 [平成25年8月26日現在]	第 16 期 [平成26年2月24日現在]
1 期首元本額	43,884,121円	464,586,331円
期中追加設定元本額	434,451,663円	694,931,787円
期中一部解約元本額	13,749,453円	388,810,335円
2 受益権の総数	464,586,331口	770,707,783口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1494円 (11,494円)	1.1732円 (11,732円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 15 期(自平成25年2月26日 至平成25年8月26日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	850,455円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,580,786円
収益調整金額	C	95,119,610円
分配準備積立金額	D	1,741,317円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	100,292,168円
当ファンドの期末残存口数	F	464,586,331口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,158円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第 16 期(自平成25年8月27日 至平成26年2月24日)

## 1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	2,443,791円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,179,663円
収益調整金額	C	164,058,312円
分配準備積立金額	D	3,004,077円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	173,685,843円
当ファンドの期末残存口数	F	770,707,783口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,253円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

## (金融商品に関する注記)

## 1 金融商品の状況に関する事項

区 分	第 15 期 (自平成25年2月26日 至平成25年8月26日)	第 16 期 (自平成25年8月27日 至平成26年2月24日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第 15 期	第 16 期
	[ 平成25年8月26日現在 ]	[ 平成26年2月24日現在 ]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	<p>売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同 左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 15 期	第 16 期
	[ 平成25年8月26日現在 ]	[ 平成26年2月24日現在 ]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,439,168	10,139,560
合計	5,439,168	10,139,560

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項  
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評 価 額	備 考
親投資信託受益証券	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	675,999,854	902,054,205	
	親投資信託受益証券 小計	675,999,854	902,054,205	
	合計	675,999,854	902,054,205	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

&lt;参考&gt;

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。  
貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

[次へ](#)

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」の状況  
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

	[ 平成25年8月26日現在 ]	[ 平成26年2月24日現在 ]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	119,259,984	186,532,875
株式 2	526,272,160	827,558,350
信用取引預け金	510,406,928	819,625,303
未収配当金	244,100	520,900
未収利息	211	311
その他未収収益	24,733	35,720
流動資産合計	1,156,208,116	1,834,273,459
資産合計	1,156,208,116	1,834,273,459
負債の部		
流動負債		
信用売証券	522,537,700	828,896,420
未払解約金	329,182	1,344,083
その他未払費用	488,718	1,079,614
流動負債合計	523,355,600	831,320,117
負債合計	523,355,600	831,320,117
純資産の部		
元本等		
元本 1	486,159,394	751,617,360
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	146,693,122	251,335,982
元本等合計	632,852,516	1,002,953,342
純資産合計	632,852,516	1,002,953,342
負債純資産合計	1,156,208,116	1,834,273,459

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月25日から8月24日まで、および8月25日から翌年2月24日までであります。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 信用売証券は個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 収益及び費用の計上基準	その他費用として、信用売り株式の借入に係る費用を、予め借入先と合意した料率と計算方法に基づき、原則として、借入実行日(信用売り受渡日)の翌営業日から日々計上しております。 また、信用売り株式の借入先に支払うべき配当金相当額を、株式の配当落ち日に計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	[ 平成25年8月26日現在 ]	[ 平成26年2月24日現在 ]
1 期首	平成25年2月26日	平成25年8月27日
期首元本額	116,239,791円	486,159,394円
期首からの追加設定元本額	370,460,802円	556,050,002円
期首からの一部解約元本額	541,199円	290,592,036円
元本の内訳*		
日本株プライムニュートラル・ファンド(ラップ向け)	409,244,481円	675,999,854円
MUAM 日本株マーケットニュートラル・ファンド(適格機関投資家限定)	76,914,913円	75,617,506円
(合計)	486,159,394円	751,617,360円
2 差入保証金代用有価証券 信用取引に係る差入保証金代用有価証券として以下の通り差入れを行っております。 株式	308,839,140円	463,456,400円
3 受益権の総数	486,159,394口	751,617,360口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3017円 (13,017円)	1.3344円 (13,344円)

\* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 1 金融商品の状況に関する事項

区 分	（自平成25年 2月26日 至平成25年 8月26日）	（自平成25年 8月27日 至平成26年 2月24日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、信用売証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左 同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成25年8月26日現在]	[平成26年2月24日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同 左
2 時価の算定方法	売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同 左

## （有価証券関係に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	[平成25年8月26日現在]	[平成26年2月24日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,066,698	10,657,406
信用売証券	9,670,504	7,926,416
合計	8,603,806	18,583,822

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

## （デリバティブ取引等関係に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

（単位：円）

コード	銘 柄 銘 柄 名	株式数	評 価 額		備 考
			単 価	金 額	
1377	サカタのタネ	2,600	1,350	3,510,000	
1515	日鉄鉱業	8,000	434	3,472,000	
1417	ミライト・ホールディングス	3,800	951	3,613,800	3,800株
1722	ミサワホーム	2,500	1,325	3,312,500	2,500株
1766	東建コーポレーション	750	4,605	3,453,750	
1801	大成建設	6,000	452	2,712,000	6,000株
1819	日鉄住金テックスエンジ	10,000	371	3,710,000	6,000株
1879	新日本建設	11,600	306	3,549,600	11,600株
1882	東亜道路工業	7,000	454	3,178,000	
1884	日本道路	5,000	496	2,480,000	
1890	東洋建設	8,700	337	2,931,900	
1896	大林道路	6,000	559	3,354,000	
1929	日特建設	9,000	373	3,357,000	9,000株

1949	住友電設	2,500	1,345	3,362,500	
1968	太平電業	6,000	648	3,888,000	5,000株
1979	大氣社	1,700	2,024	3,440,800	
6330	東洋エンジニアリング	8,000	474	3,792,000	8,000株
2229	カルビー	1,400	2,530	3,542,000	1,000株
2282	日本ハム	2,000	1,631	3,262,000	
2292	S Foods	3,000	1,066	3,198,000	
2602	日清オイリオグループ	11,000	336	3,696,000	
2613	J-オイルミルズ	13,000	275	3,575,000	
2815	アリアケジャパン	1,400	2,447	3,425,800	
2910	ロック・フィールド	1,900	1,825	3,467,500	1,900株
3104	富士紡ホールディングス	17,000	218	3,706,000	17,000株
3105	日清紡ホールディングス	4,000	888	3,552,000	
3109	シキボウ	30,000	120	3,600,000	23,000株
3302	帝国繊維	2,500	1,404	3,510,000	2,500株
3593	ホギメディカル	600	5,460	3,276,000	
8011	三陽商会	12,000	288	3,456,000	12,000株
3864	三菱製紙	36,000	94	3,384,000	34,000株
3877	中越バルブ工業	16,000	215	3,440,000	16,000株
3946	トーモク	12,000	318	3,816,000	10,000株
4004	昭和電工	24,000	151	3,624,000	24,000株
4027	テイカ	9,000	293	2,637,000	9,000株
4028	石原産業	31,000	111	3,441,000	
4078	堺化学工業	11,000	313	3,443,000	11,000株
4116	大日精化学工業	8,000	444	3,552,000	8,000株
4118	カネカ	6,000	658	3,948,000	6,000株
4182	三菱瓦斯化学	5,000	686	3,430,000	4,000株
4185	J S R	1,400	1,751	2,451,400	
4201	日本合成化学工業	4,000	875	3,500,000	4,000株
4203	住友ベークライト	9,000	395	3,555,000	9,000株
4204	積水化学工業	3,000	1,161	3,483,000	3,000株
4208	宇部興産	18,000	189	3,402,000	
4215	タキロン	8,000	441	3,528,000	8,000株
4217	日立化成	2,400	1,453	3,487,200	1,900株
4228	積水化成工業	13,000	263	3,419,000	13,000株
4272	日本化薬	3,000	1,369	4,107,000	2,000株
4901	富士フイルムホールディングス	1,300	2,972	3,863,600	900株
4924	ドクターシーラボ	1,100	3,105	3,415,500	
4928	ノエビアホールディングス	1,900	1,819	3,456,100	
4956	コニシ	1,900	1,815	3,448,500	
4968	荒川化学工業	4,100	902	3,698,200	4,100株
4985	アース製薬	1,000	3,555	3,555,000	300株
7917	藤森工業	1,400	2,364	3,309,600	1,400株
7925	前澤化成工業	1,900	1,053	2,000,700	1,600株
7942	J S P	2,200	1,510	3,322,000	2,200株
4516	日本新薬	2,000	1,956	3,912,000	
4530	久光製薬	800	4,745	3,796,000	800株
4550	日水製薬	3,600	1,065	3,834,000	3,600株
4551	鳥居薬品	1,100	3,410	3,751,000	1,100株
4555	沢井製薬	500	6,280	3,140,000	500株
4578	大塚ホールディングス	1,200	3,120	3,744,000	1,000株
4581	大正製薬ホールディングス	500	7,640	3,820,000	400株
5007	コスモ石油	17,000	201	3,417,000	17,000株
5017	富士石油	11,400	303	3,454,200	4,500株
5019	出光興産	1,600	2,192	3,507,200	1,100株
5101	横浜ゴム	4,000	960	3,840,000	4,000株
5192	三ツ星ベルト	6,000	553	3,318,000	
5195	バンドー化学	9,000	396	3,564,000	
5201	旭硝子	6,000	563	3,378,000	5,000株
5288	ジャパンパイル	3,500	895	3,132,500	3,500株
5332	TOTO	2,000	1,476	2,952,000	2,000株
5351	品川リフラクトリーズ	15,000	224	3,360,000	15,000株
7943	ニチハ	2,500	1,275	3,187,500	
5406	神戸製鋼所	24,000	140	3,360,000	
5413	日新製鋼ホールディングス	3,000	1,020	3,060,000	3,000株
5423	東京製鐵	7,300	494	3,606,200	
5541	大平洋金属	11,000	336	3,696,000	
5659	日本精線	5,000	422	2,110,000	5,000株
5706	三井金属鉱業	13,000	271	3,523,000	
5851	リョービ	9,000	358	3,222,000	7,000株

3443	川田テクノロジーズ	1,300	2,709	3,521,700	1,300株
5901	東洋製罐グループホールディングス	1,900	1,833	3,482,700	1,900株
5911	横河ブリッジホールディングス	3,000	1,330	3,990,000	
5975	東プレ	2,900	1,274	3,694,600	
5976	高周波熱錬	4,700	723	3,398,100	
5991	日本発條	3,200	1,051	3,363,200	3,200株
6013	タクマ	4,000	879	3,516,000	
6104	東芝機械	7,000	494	3,458,000	6,000株
6272	レオン自動機	6,000	588	3,528,000	
6302	住友重機械工業	7,000	468	3,276,000	7,000株
6306	日工	7,000	548	3,836,000	6,000株
6317	北川鉄工所	18,000	185	3,330,000	
6326	クボタ	2,000	1,428	2,856,000	2,000株
6332	月島機械	3,000	1,100	3,300,000	
6339	新東工業	5,000	738	3,690,000	5,000株
6349	小森コーポレーション	2,500	1,334	3,335,000	2,200株
6355	住友精密工業	9,000	408	3,672,000	
6373	大同工業	13,000	286	3,718,000	
6390	加藤製作所	5,000	639	3,195,000	5,000株
6417	SANKYO	800	4,145	3,316,000	600株
6420	福島工業	2,500	1,533	3,832,500	1,900株
6461	日本ピストンリング	19,000	193	3,667,000	19,000株
6470	大豊工業	3,200	1,008	3,225,600	3,200株
6472	NTN	9,000	384	3,456,000	
6473	ジェイテクト	2,400	1,559	3,741,600	1,800株
6480	日本トムソン	7,000	535	3,745,000	7,000株
6490	日本ビラー工業	5,100	722	3,682,200	
4902	コニカミノルタ	3,500	1,065	3,727,500	3,000株
6503	三菱電機	3,000	1,196	3,588,000	2,000株
6506	安川電機	2,000	1,529	3,058,000	2,000株
6594	日本電産	300	12,165	3,649,500	300株
6622	ダイヘン	8,000	425	3,400,000	
6641	日新電機	7,000	540	3,780,000	
6644	大崎電気工業	6,000	636	3,816,000	6,000株
6727	ワコム	5,400	632	3,412,800	
6756	日立国際電気	3,000	1,376	4,128,000	3,000株
6762	TDK	800	4,410	3,528,000	
6773	パイオニア	16,300	226	3,683,800	
6788	日本トリム	500	6,360	3,180,000	400株
6794	フォスター電機	2,000	1,715	3,430,000	2,000株
6798	SMK	7,000	484	3,388,000	
6804	ホシデン	7,200	494	3,556,800	7,200株
6816	アルパイン	2,400	1,428	3,427,200	2,400株
6844	新電元工業	6,000	522	3,132,000	
6875	メガチップス	2,700	1,259	3,399,300	
6915	千代田インテグレ	1,900	1,802	3,423,800	1,700株
6935	日本デジタル研究所	2,400	1,416	3,398,400	
6947	図研	4,300	802	3,448,600	
6951	日本電子	8,000	380	3,040,000	
6958	日本シイエムケイ	12,500	261	3,262,500	
6961	エンプラス	600	6,330	3,798,000	500株
6966	三井ハイテック	5,500	680	3,740,000	4,600株
6996	ニチコン	4,400	863	3,797,200	3,600株
6997	日本ケミコン	11,000	343	3,773,000	9,000株
8035	東京エレクトロン	600	5,809	3,485,400	600株
3116	トヨタ紡織	3,200	1,088	3,481,600	
5196	鬼怒川ゴム工業	8,000	458	3,664,000	6,000株
5949	ユニプレス	2,200	1,879	4,133,800	1,900株
7122	近畿車輛	10,000	332	3,320,000	10,000株
7226	極東開発工業	2,600	1,327	3,450,200	2,600株
7243	シロキ工業	15,000	215	3,225,000	
7248	カルソニックカンセイ	7,000	542	3,794,000	
7250	太平洋工業	5,200	643	3,343,600	
7256	河西工業	5,000	709	3,545,000	5,000株
7269	スズキ	1,200	2,676	3,211,200	
7270	富士重工業	1,300	2,769	3,599,700	900株
7277	TBK	6,000	537	3,222,000	6,000株
7282	豊田合成	1,700	2,163	3,677,100	1,200株
7730	マニー	900	3,765	3,388,500	
7744	ノーリツ鋼機	5,900	642	3,787,800	5,900株

7817	パラマウントベッドホールディングス	1,100	3,210	3,531,000	
7911	凸版印刷	3,000	749	2,247,000	
7949	小松ウオール工業	1,900	2,037	3,870,300	1,400株
7955	クリナップ	4,100	818	3,353,800	
7956	ビジョン	700	4,510	3,157,000	700株
7976	三菱鉛筆	1,500	2,423	3,634,500	
9533	東邦瓦斯	5,000	510	2,550,000	
9543	静岡瓦斯	6,000	595	3,570,000	
9009	京成電鉄	4,000	901	3,604,000	3,000株
9025	鴻池運輸	2,600	1,380	3,588,000	2,600株
9042	阪急阪神ホールディングス	7,000	548	3,836,000	7,000株
9069	センコー	7,000	508	3,556,000	7,000株
9070	トナミホールディングス	10,000	194	1,940,000	4,000株
9066	日新	12,000	282	3,384,000	
1973	NECネットエスアイ	1,500	2,304	3,456,000	1,200株
3817	SRAホールディングス	2,500	1,356	3,390,000	
4283	パナソニック インフォメーションシステムズ	1,200	2,748	3,297,600	1,100株
4704	トレンドマイクロ	1,100	3,435	3,778,500	
4725	シーエーシー	3,800	964	3,663,200	3,800株
4839	WOWOW	1,000	3,460	3,460,000	1,000株
7595	アルゴグラフィックス	2,000	1,706	3,412,000	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	6,800	535	3,638,000	2,100株
9432	日本電信電話	400	5,716	2,286,400	200株
9435	光通信	400	9,060	3,624,000	300株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,000	4,050	4,050,000	800株
9746	T K C	1,900	1,903	3,615,700	1,900株
9759	N S D	2,600	1,316	3,421,600	2,600株
2715	エレマテック	1,900	1,897	3,604,300	1,900株
2768	双日	19,800	182	3,603,600	16,000株
7433	伯東	3,600	1,016	3,657,600	
7537	丸文	6,000	570	3,420,000	
7599	ガリバーインターナショナル	4,900	800	3,920,000	
8020	兼松	22,000	164	3,608,000	22,000株
8037	カメイ	4,900	780	3,822,000	3,700株
8051	山善	5,700	606	3,454,200	
8057	内田洋行	14,000	291	4,074,000	14,000株
8097	三愛石油	7,000	538	3,766,000	7,000株
8098	稲畑産業	3,600	1,043	3,754,800	1,700株
8103	明和産業	9,800	362	3,547,600	
8125	ワキタ	3,000	1,208	3,624,000	
8130	サンゲツ	1,400	2,507	3,509,800	
8150	三信電気	4,700	726	3,412,200	4,700株
8154	加賀電子	2,700	1,269	3,426,300	2,700株
8283	P a l t a c	2,600	1,361	3,538,600	2,100株
9810	日鉄住金物産	9,000	405	3,645,000	9,000株
9869	加藤産業	1,800	1,915	3,447,000	
9963	江守商事	1,800	1,844	3,319,200	1,600株
2664	カワチ薬品	1,800	1,896	3,412,800	1,800株
2681	ゲオホールディングス	3,800	937	3,560,600	
2685	アダストリアホールディングス	1,400	2,480	3,472,000	900株
2753	あみやき亭	1,100	3,015	3,316,500	
3097	物語コーポレーション	1,100	3,065	3,371,500	700株
3175	エー・ピーカンパニー	2,000	1,900	3,800,000	1,800株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,200	2,978	3,573,600	1,200株
3391	ツルハホールディングス	400	9,660	3,864,000	400株
3395	サンマルクホールディングス	700	4,770	3,339,000	
7581	サイゼリヤ	2,700	1,233	3,329,100	2,700株
7616	コロワイド	3,000	1,111	3,333,000	
7630	荳番屋	900	3,820	3,438,000	
8028	ファミリーマート	800	4,630	3,704,000	500株
8233	高島屋	4,000	922	3,688,000	
8255	アクシアル リテイリング	2,200	1,551	3,412,200	1,900株
8270	ユニグループ・ホールディングス	5,600	636	3,561,600	
9831	ヤマダ電機	10,600	334	3,540,400	8,700株
9979	大庄	2,700	1,279	3,453,300	
9994	やまや	1,700	2,095	3,561,500	1,700株
3231	野村不動産ホールディングス	1,600	2,209	3,534,400	1,400株
3254	プレサンスコーポレーション	1,200	2,766	3,319,200	

3288	オープンハウス	2,100	2,044	4,292,400	2,100株
8804	東京建物	4,000	881	3,524,000	
8840	大京	14,000	236	3,304,000	14,000株
8881	日神不動産	9,600	378	3,628,800	7,600株
8897	タカラレーベン	10,900	306	3,335,400	10,900株
8928	穴吹興産	11,000	306	3,366,000	9,000株
8935	エフ・ジェー・ネクスト	7,200	516	3,715,200	5,100株
1954	日本工営	8,000	450	3,600,000	3,000株
2183	リニカル	2,300	932	2,143,600	2,300株
2301	学情	4,400	773	3,401,200	4,400株
2305	スタジオアリス	2,500	1,352	3,380,000	
2371	カカクコム	1,500	1,727	2,590,500	1,500株
4321	ケネディクス	8,800	380	3,344,000	8,800株
4544	みらかホールディングス	800	4,720	3,776,000	600株
4661	オリエンタルランド	200	15,505	3,101,000	200株
4745	東京個別指導学院	9,600	389	3,734,400	
9728	日本管財	1,700	1,983	3,371,100	1,700株
9755	応用地質	2,200	1,541	3,390,200	
	合 計	1,333,150		827,558,350	

(注)備考欄の数値は、差入保証金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

- (2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

(単位:円)

銘 柄	信 用 取 引		備 考
	売建株数	評価額	
日本水産	11,300	2,587,700	
マルハニチロホールディングス	20,000	3,540,000	
ショーボンドホールディングス	700	3,293,500	
三井松島産業	24,000	3,720,000	
コムシスホールディングス	2,200	3,621,200	
清水建設	7,000	3,801,000	
長谷工コーポレーション	4,700	3,186,600	
西松建設	9,000	3,231,000	
奥村組	8,000	3,648,000	
北野建設	12,000	3,228,000	
矢作建設工業	3,600	3,394,800	
大東建託	400	3,837,600	
五洋建設	9,000	3,366,000	
日成ビルド工業	13,000	3,042,000	
巴コーポレーション	8,100	3,361,500	
ライト工業	4,200	3,561,600	
協和エクシオ	2,600	3,710,200	
九電工	4,000	3,100,000	
中外炉工業	15,000	3,375,000	
高砂熱学工業	3,600	3,700,800	
日比谷総合設備	2,900	3,439,400	
昭和産業	10,000	3,480,000	
タケエイ	3,300	3,204,300	
テンプホールディングス	1,100	3,349,500	
森永製菓	15,000	3,375,000	
江崎グリコ	2,000	2,842,000	
亀田製菓	1,200	3,486,000	
シミックホールディングス	2,600	3,689,400	
システナ	4,600	3,638,600	
新日鉄住金ソリューションズ	1,300	3,529,500	
日本駐車場開発	33,000	3,564,000	
ツクイ	3,300	3,352,800	
コカ・コーライーストジャパン	1,500	3,420,000	
サントリー食品インターナショナル	1,000	3,505,000	
ローソン	500	3,670,000	
エディオン	6,500	3,497,000	
J Pホールディングス	7,200	3,398,400	
ハニーズ	3,820	3,460,920	
東洋水産	1,000	3,435,000	
あい ホールディングス	2,600	4,167,800	
J・フロント リテイリング	5,000	3,575,000	
日東紡績	8,000	3,464,000	

日本毛織	4,000	2,896,000
常和ホールディングス	1,000	3,220,000
東レ	5,000	3,565,000
T S Iホールディングス	5,500	3,426,500
大王製紙	4,000	3,992,000
日産化学工業	2,400	3,669,600
信越化学工業	600	3,417,000
エア・ウォーター	2,000	3,086,000
日本パーカライジング	2,000	4,558,000
保土谷化学工業	18,000	3,420,000
三井化学	13,000	3,549,000
アイカ工業	1,600	3,412,800
リケンテクノス	6,000	3,312,000
群栄化学工業	7,000	2,870,000
ミライアル	2,300	3,233,800
大日本住友製薬	2,100	3,759,000
塩野義製薬	1,700	3,546,200
あすか製薬	3,600	3,366,000
日本ケミファ	6,000	3,168,000
J C Rファーマ	1,500	3,655,500
ゼリア新薬工業	1,300	3,209,700
大幸薬品	1,500	3,343,500
日本ペイント	2,000	3,100,000
関西ペイント	3,000	4,113,000
太陽ホールディングス	1,000	3,380,000
フジ・メディア・ホールディングス	1,900	3,551,100
リゾートトラスト	1,900	3,273,700
ヤフー	5,500	3,503,500
もしもしホットライン	3,500	3,458,000
日本オラクル	800	3,512,000
ユー・エス・エス	2,500	3,537,500
サイボウズ	9,000	3,276,000
高砂香料工業	6,000	3,534,000
ポーラ・オルビスホールディングス	900	3,640,500
エステー	2,500	2,475,000
星光P M C	6,500	6,656,000
メック	3,300	3,207,600
クミアイ化学工業	6,000	3,444,000
日本農薬	2,000	2,894,000
東燃ゼネラル石油	4,000	3,652,000
ブリヂストン	800	2,941,600
日本板硝子	25,000	3,475,000
デイ・シイ	6,200	3,509,200
日本ヒューム	2,000	1,648,000
日本コンクリート工業	8,000	3,240,000
東海カーボン	11,000	3,465,000
日本カーボン	19,000	3,629,000
東洋炭素	1,600	3,340,800
フジインコーポレーテッド	2,800	3,122,000
共英製鋼	1,600	3,152,000
大和工業	1,100	3,487,000
大同特殊鋼	7,000	3,388,000
日本高周波鋼業	33,000	3,333,000
日本冶金工業	12,500	3,375,000
愛知製鋼	6,000	2,532,000
古河機械金属	18,000	3,294,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	3,204,000
東邦チタニウム	3,100	1,977,800
三和ホールディングス	5,000	3,480,000
長府製作所	1,500	3,667,500
リンナイ	400	3,412,000
岡部	2,600	3,601,000
三浦工業	900	2,399,400
ツガミ	6,000	3,714,000
オークマ	4,000	3,604,000
旭ダイヤモンド工業	3,000	3,615,000
D M G 森精機	2,100	3,427,200
ディスコ	500	3,285,000
やまびこ	1,000	3,665,000
ナブテスコ	1,500	3,726,000

小松製作所	900	1,917,000
井関農機	12,000	3,432,000
帝国電機製作所	1,100	3,275,800
千代田化工建設	2,000	3,050,000
オルガノ	7,000	3,276,000
椿本チエイン	4,000	3,320,000
日機装	2,800	3,668,000
ダイコク電機	1,400	3,375,400
サンデン	7,000	3,906,000
ホシザキ電機	1,000	3,685,000
キッツ	7,200	3,528,000
シンフォニアテクノロジー	21,000	3,381,000
明電舎	8,000	3,360,000
日立工機	4,700	3,586,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,000	3,540,000
富士通	6,000	3,810,000
サンケン電気	5,000	3,455,000
アルバック	1,700	3,384,700
E I Z O	1,100	3,030,500
日本信号	3,800	3,480,800
ミツミ電機	4,700	3,600,200
アルプス電気	2,600	3,387,800
日本航空電子工業	2,000	3,152,000
船井電機	2,800	3,119,200
横河電機	2,300	3,551,200
アズビル	1,400	3,500,000
日本光電工業	800	3,348,000
堀場製作所	900	3,631,500
日置電機	2,500	3,490,000
シスメックス	600	3,420,000
OBARA GROUP	900	3,609,000
デンソー	600	3,242,400
スタンレー電気	1,500	3,523,500
岩崎電気	15,000	3,840,000
日本セラミック	2,100	3,553,200
ファナック	200	3,423,000
浜松ホトニクス	800	3,436,000
太陽誘電	2,800	3,575,600
村田製作所	400	3,799,600
双葉電子工業	2,600	3,309,800
日東電工	800	3,717,600
北陸電気工業	23,000	3,220,000
日立造船	5,900	3,433,800
川崎重工業	8,000	3,328,000
日本車輛製造	7,000	3,465,000
ニチユ三菱フォークリフト	4,000	2,892,000
日産自動車	3,700	3,396,600
トヨタ自動車	600	3,554,400
武蔵精密工業	1,800	3,477,600
日産車体	2,000	2,790,000
新明和工業	4,000	3,452,000
日信工業	1,400	2,843,400
トビー工業	19,000	3,420,000
タチエス	2,400	3,496,800
フタバ産業	7,800	3,494,400
プレス工業	5,000	2,070,000
エフ・シー・シー	1,800	3,272,400
シマノ	400	3,520,000
テイ・エス テック	1,000	3,385,000
ナガイレーベン	1,900	3,372,500
松田産業	2,500	3,200,000
メディカルホールディングス	2,200	3,454,000
コーナン商事	3,300	3,507,900
ワタミ	2,300	3,530,500
ゼンショーホールディングス	2,900	3,520,600
東京計器	12,000	3,516,000
トプコン	2,300	3,546,600
タムロン	1,400	3,407,600
リコー	2,800	3,542,000
大研医器	1,900	3,389,600

前田工織	2,400	3,585,600
永大産業	6,000	3,570,000
フジシールインターナショナル	1,000	3,645,000
図書印刷	9,000	4,167,000
日本写真印刷	2,200	3,242,800
ローランド	2,500	3,555,000
信越ポリマー	9,500	3,477,000
イトーキ	5,600	3,556,000
任天堂	300	3,765,000
日本バルカー工業	12,000	3,384,000
丸紅	5,000	3,605,000
ヨンドシーホールディングス	2,200	3,526,600
長瀬産業	2,900	3,607,600
三共生興	9,600	3,504,000
美津濃	6,000	3,372,000
日立ハイテクノロジーズ	1,400	3,441,200
日本ユニシス	3,100	3,546,400
菱洋エレクトロ	3,200	3,536,000
ユアサ商事	16,000	3,376,000
岩谷産業	5,000	3,140,000
ユニ・チャーム	600	3,541,200
シナネン	6,000	2,436,000
東陽テクニカ	3,400	3,440,800
木曽路	1,800	3,349,800
ケーヨー	7,300	3,372,600
アデランス	3,200	3,577,600
上新電機	4,000	3,156,000
ベスト電器	14,500	1,972,000
オークワ	4,000	3,432,000
コメリ	1,200	2,967,600
しまむら	400	3,692,000
ニッセンホールディングス	8,100	3,393,900
三菱地所	1,000	2,471,000
住友不動産	1,000	4,239,000
テーオーシー	4,600	3,454,600
住友不動産販売	1,100	3,470,500
リロ・ホールディング	700	3,885,000
京浜急行電鉄	4,000	3,456,000
富士急行	4,000	3,624,000
サカイ引越センター	900	3,145,500
近畿日本鉄道	10,000	3,580,000
トランコム	1,000	3,500,000
福山通運	6,000	3,498,000
東京放送ホールディングス	3,200	3,520,000
コネクシオ	4,000	3,400,000
東京瓦斯	7,000	3,500,000
西部瓦斯	15,000	3,645,000
西尾レントオール	1,200	3,678,000
トランス・コスモス	1,500	3,381,000
乃村工藝社	4,300	3,452,900
S C S K	1,200	3,702,000
セコム	600	3,447,600
メイテック	800	2,155,200
ニチイ学館	3,900	3,724,500
吉野家ホールディングス	2,300	3,381,000
イエローハット	1,700	3,301,400
富士エレクトロニクス	2,500	3,447,500
松屋フーズ	1,900	3,490,300
サガミチェーン	4,000	3,808,000
ミスミグループ本社	1,200	3,597,600
ジェコス	3,700	3,374,400

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## &lt;更新後&gt;

## 【純資産額計算書】

平成26年3月31日現在

(単位：円)

資産総額	972,955,680
負債総額	2,979,635
純資産総額( - )	969,976,045
発行済口数	846,996,521 口
1口当たり純資産価額( / )	1.1452 ( 1万口当たり 11,452 )

## &lt;参考&gt;

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」の現況

## 純資産額計算書

平成26年3月31日現在

(単位：円)

資産総額	1,951,935,086
負債総額	885,745,507
純資産総額( - )	1,066,189,579
発行済口数	817,770,938 口
1口当たり純資産価額( / )	1.3038 ( 1万口当たり 13,038 )

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額等

###### <訂正前>

平成25年9月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### <訂正後>

平成26年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

###### (2) 委託会社の機構

###### <訂正前>

(略)

ファンドの運用体制等は平成25年9月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

###### <訂正後>

(略)

ファンドの運用体制等は平成26年3月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

##### <更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成26年3月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	482	6,798,867
追加型公社債投資信託	18	727,278
単位型株式投資信託	21	421,889
単位型公社債投資信託	5	185,166
合計	526	8,133,199

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

### 3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

#### (1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

#### (2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第29期事業年度に係る中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（第28期事業年度の財務諸表は省略）

<追加>  
 中間財務諸表  
 (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在)
<b>(資産の部)</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金		23,548,500
有価証券		6,562,983
前払費用		236,694
未収入金		335,237
未収委託者報酬		4,948,498
未収収益		56,552
繰延税金資産		385,903
金銭の信託		30,000
その他		57,563
<b>流動資産合計</b>		<b>36,161,935</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
建物	1	259,238
器具備品	1	174,123
土地		1,205,031
<b>有形固定資産合計</b>		<b>1,638,393</b>
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		1,060,576
ソフトウェア仮勘定		242,958
<b>無形固定資産合計</b>		<b>1,319,357</b>
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		16,782,208
関係会社株式		320,136
長期性預金		2,000,000
長期差入保証金		819,880
繰延税金資産		49,612
その他		15,035
<b>投資その他の資産合計</b>		<b>19,986,873</b>
<b>固定資産合計</b>		<b>22,944,625</b>
<b>資産合計</b>		<b>59,106,560</b>

(単位：千円)

第29期中間会計期間  
(平成25年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

預り金		61,657
未払金		
未払収益分配金		63,875
未払償還金		946,113
未払手数料		1,982,655
その他未払金		72,079
未払費用		1,409,174
未払消費税等	2	176,997
未払法人税等		1,913,828
賞与引当金		534,891
その他		400,856
流動負債合計		<u>7,562,129</u>

## 固定負債

退職給付引当金		246,154
役員退職慰労引当金		53,775
時効後支払損引当金		198,603
固定負債合計		<u>498,533</u>

## 負債合計

8,060,662

## (純資産の部)

## 株主資本

資本金		2,000,131
資本剰余金		
資本準備金		222,096
資本剰余金合計		<u>222,096</u>
利益剰余金		
利益準備金		342,589
その他利益剰余金		
別途積立金		6,998,000
繰越利益剰余金		39,994,517
利益剰余金合計		<u>47,335,107</u>
株主資本合計		<u>49,557,335</u>

## 評価・換算差額等

その他有価証券		1,488,562
評価差額金		
評価・換算差額等合計		<u>1,488,562</u>

## 純資産合計

51,045,897

## 負債純資産合計

59,106,560

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	26,575,676
投資顧問料	53,790
その他営業収益	55,619
営業収益合計	26,685,086
営業費用	
支払手数料	10,846,750
広告宣伝費	330,957
公告費	1,062
調査費	
調査費	486,652
委託調査費	5,888,736
事務委託費	116,669
営業雑経費	
通信費	46,024
印刷費	243,552
協会費	20,030
諸会費	4,256
事務機器関連費	509,881
その他営業雑経費	4,944
営業費用合計	18,499,516
一般管理費	
給料	
役員報酬	103,937
給料・手当	1,649,702
賞与引当金繰入	534,891
福利厚生費	294,158
交際費	10,544
旅費交通費	75,335
租税公課	62,774
不動産賃借料	349,810
退職給付費用	192,772
役員退職慰労引当金繰入	11,027
固定資産減価償却費	1 214,015
諸経費	136,511
一般管理費合計	3,635,481
営業利益	4,550,087

(単位：千円)

第29期中間会計期間	
(自 平成25年4月1日	
至 平成25年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	150,506
有価証券利息	2,185
受取利息	10,693
投資有価証券償還益	1,862
収益分配金等時効完成分	54,825
その他	1,293
営業外収益合計	221,366
営業外費用	
その他	4,535
営業外費用合計	4,535
経常利益	4,766,918
特別利益	
投資有価証券売却益	177,223
特別利益合計	177,223
特別損失	
投資有価証券売却損	34,236
固定資産除却損	462
特別損失合計	34,698
税引前中間純利益	4,909,443
法人税、住民税及び事業税	1,913,166
法人税等調整額	17,360
法人税等合計	1,895,805
中間純利益	3,013,637

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,131
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
資本剰余金合計	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	342,589
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	6,998,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	6,998,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	39,686,216
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
当中間期変動額合計	308,301
当中間期末残高	39,994,517
利益剰余金合計	
当期首残高	47,026,806
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
当中間期変動額合計	308,301
当中間期末残高	47,335,107
株主資本合計	
当期首残高	49,249,033
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
当中間期変動額合計	308,301
当中間期末残高	49,557,335
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	1,797,355

当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	308,792
当中間期変動額合計	308,792
当中間期末残高	1,488,562
評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,797,355
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	308,792
当中間期変動額合計	308,792
当中間期末残高	1,488,562
純資産合計	
当期首残高	51,046,388
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,705,336
中間純利益	3,013,637
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	308,792
当中間期変動額合計	490
当中間期末残高	51,045,897

## [重要な会計方針]

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

数理計算上の差異は、その発生年度の翌事業年度より一括費用処理することとしております。

## (会計上の見積もりの変更)

数理計算上の差異は、従来、発生年度の従業員の平均支払期間内の一定の年数(8年)により費用処理しておりましたが、当中間会計期間において、平均支払期間が8年を下回ったことから、数理計算上の差異を一括費用処理する方法に見直し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税金等調整前中間純利益はそれぞれ108百万円減少しております。

## (3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

## (4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

## 4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

## [注記事項]

## (中間貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在)	
建物	245,895千円
器具備品	349,802千円

## 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

## (中間損益計算書関係)

## 1 減価償却実施額

第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)	
有形固定資産	39,230千円
無形固定資産	174,785千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日至平成25年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数 (株)	当中間会計期間 減少株式数 (株)	当中間会計期間末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

## 2. 配当に関する事項

平成25年6月24日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,705,336千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	21,800円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

## (金融商品関係)

第29期中間会計期間(平成25年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表 計上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	23,548,500	23,548,500	-
(2) 有価証券	6,562,983	6,562,983	-
(3) 未収委託者報酬	4,948,498	4,948,498	-
(4) 長期性預金	2,000,000	2,000,898	898
(5) 投資有価証券	16,743,308	16,743,308	-
資産計	53,803,291	53,804,190	898
(1) 未払手数料	1,982,655	1,982,655	-
(2) 未払法人税等	1,913,828	1,913,828	-
負債計	3,896,483	3,896,483	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

## (1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2)有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっており、投資信託は基準価額によっております。

## (4)長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

## (5)投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負 債

## (1)未払手数料、(2)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式(中間貸借対照表計上額38,900千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## （注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## （有価証券関係）

第29期中間会計期間（平成25年9月30日現在）

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	11,667,373	9,779,767	1,887,605
	小計	11,667,373	9,779,767	1,887,605
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	5,638,918	5,667,796	28,877
	小計	5,638,918	5,667,796	28,877
合計		17,306,292	15,447,564	1,858,727

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （デリバティブ取引関係）

重要な取引はありません。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第29期中間会計期間（自平成25年4月1日至平成25年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 (平成25年9月30日現在)
1株当たり純資産額	411,335.37円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	51,045,897
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	51,045,897
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	124,098

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日 至平成25年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	24,284.33円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	3,013,637
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	3,013,637
普通株式の期中平均株式数(株)	124,098

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

## 5【その他】

## 定款の変更等

## &lt;訂正前&gt;

平成25年6月21日付で、定款について次の変更を行いました。

- ・公告方法の変更（日本経済新聞に掲載する方法から電子公告（ただし、事故その他やむを得ない事由によって電子公告による公告ができない場合は日本経済新聞に掲載する方法による）に変更）

## &lt;訂正後&gt;

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

**第2【その他の関係法人の概況】****1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社**

&lt; 訂正前 &gt;

( 略 )

資本金の額：324,279百万円（平成25年3月末現在）

( 略 )

&lt; 訂正後 &gt;

( 略 )

資本金の額：324,279百万円（平成25年9月末現在）

( 略 )

**(2) 販売会社**

&lt; 更新後 &gt;

名称	資本金の額 (平成25年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

**3【資本関係】**

&lt; 訂正前 &gt;

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成25年9月末現在）

( 略 )

&lt; 訂正後 &gt;

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。（平成26年3月末現在）

( 略 )

## 独立監査人の監査報告書

平成26年4月2日

三菱UFJ投信株式会社  
取締役会御中

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の平成25年8月27日から平成26年2月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の平成26年2月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

三菱UFJ投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	樋口 誠之	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。